

TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG

Khoa/Viện: Kế toán - tài chính

Bộ môn: Tài chính – ngân hàng

ĐỀ CƯƠNG HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần:

Tên học phần:

- Tiếng Việt: **LẬP VÀ THẨM ĐỊNH DỰ ÁN ĐẦU TƯ**
- Tiếng Anh: **INVESTMENT PROJECT PREPARATION AND APPRAISAL**

Mã học phần: FIB330

Số tín chỉ: 2 (2-0)

Đào tạo trình độ: đại học

Học phần tiên quyết: Kế toán tài chính, Quản trị tài chính

2. Mô tả tóm tắt học phần:

Trang bị kiến thức và kỹ năng cần thiết để tham gia lập và thẩm định một dự án đầu tư về các khía cạnh phân tích thị trường đầu ra, phân tích các yếu tố đầu vào và tổ chức nhân sự, phân tích tài chính, và phân tích kinh tế xã hội.

3. Mục tiêu:

Giúp sinh viên có kiến thức và kỹ năng cần thiết để phục vụ hiệu quả cho công việc tham gia lập và thẩm định một dự án đầu tư.

4. Kết quả học tập mong đợi (KQHT): Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

- Hiểu các kiến thức tổng quan về đầu tư, dự án đầu tư, lập và thẩm định dự án đầu tư.
- Phân tích được các nội dung về thị trường đầu ra của sản phẩm dịch vụ của một dự án đầu tư.
- Phân tích được các nội dung cơ bản về các yếu tố đầu vào và tổ chức nhân sự của một dự án đầu tư.
- Biết dự tính vốn đầu tư, doanh thu, chi phí, lãi lỗ, xây dựng ngân lưu, tính toán các chỉ tiêu hiệu quả tài chính và phân tích rủi ro tài chính của một dự án đầu tư, biết sử dụng phần mềm excel và crystal ball để phân tích tài chính dự án đầu tư.
- Xây dựng ngân lưu theo quan điểm kinh tế và biết phân tích các chỉ tiêu hiệu quả kinh tế xã hội của một dự án đầu tư.

5. Nội dung:

STT	Chương/Chủ đề	Nhằm đạt KQHT	Số tiết	
			LT	TH
1	Tổng quan về lập và thẩm định dự án đầu tư		6	0
1.1	Đầu tư	a		
1.2	Dự án đầu tư	a		
1.3	Lập dự án đầu tư	a		

1.4	Thẩm định dự án đầu tư	a		
2	Phân tích thị trường		7	0
2.1	Xác định thị trường mục tiêu	b		
2.2	Xác định cung cầu hiện tại	b		
2.3	Dự báo cung cầu tương lai	b		
2.4	Phân tích khả năng cạnh tranh và chiếm lĩnh thị trường	b		
3	Phân tích kỹ thuật và tổ chức nhân sự		8	0
3.1	Công suất	c		
3.2	Địa điểm	c		
3.3	Thiết kế, xây dựng, và tổ chức thi công	c		
3.4	Công nghệ, thiết bị	c		
3.5	Nguyên vật liệu, nhiên liệu, điện, nước	c		
3.6	Tác động môi trường	c		
3.7	Tổ chức nhân sự	c		
4	Phân tích tài chính		20	0
4.1	Dự tính vốn đầu tư và nguồn vốn	d		
4.2	Dự tính doanh thu, chi phí, lãi lỗ	d		
4.3	Xây dựng kế hoạch ngân lưu	d		
4.4	Phân tích các chỉ tiêu hiệu quả tài chính	d		
4.5	Phân tích rủi ro tài chính	d		

6. Tài liệu dạy và học:

STT	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Tài liệu chính	Tham khảo
1	Nhóm GV bộ môn TCNH	Lập và thẩm định dự án đầu tư	2017	LH nội bộ	Thư viện	x	
2	Nguyễn Bạch Nguyệt	Giáo trình lập dự án đầu tư	2012	NXB Đại học Kinh tế Quốc dân	Thư viện		x
3	Vũ Công Tuấn	Thiết lập và thẩm định dự án đầu tư : Lý thuyết và bài tập	2010	NXB thống kê	Thư viện		x

7. Đánh giá kết quả học tập:

STT	Hình thức đánh giá	Nhằm đạt KQHT	Trọng số (%)
-----	--------------------	---------------	--------------

1	Tiểu luận, kiểm tra giữa kỳ	a,b,c,d	40%
2	Chuyên cần/thái độ	a,b,c,d,e	10%
3	Thi kết thúc học phần	a,b,c,d,e	50%

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN
(Ký và ghi họ tên)

ThS. Lê Thị Thùy Dương ThS Phan Thị Lệ Thúy ThS. Phạm Thị Phương Uyên

TRƯỞNG KHOA/VIỆN
(Ký và ghi họ tên)

TRƯỞNG BỘ MÔN
(Ký và ghi họ tên)

TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG

Khoa : Kế toán Tài chính

Bộ môn: Tài chính Ngân hàng

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần: **LẬP VÀ THẨM ĐỊNH DỰ ÁN ĐẦU TƯ**

Tên học phần:

- Tiếng Việt: Lập và Thẩm định Dự án đầu tư
- Tiếng Anh: Investment Project Preparation and Appraisal

Mã học phần: FIB330 Số tín chỉ: 2(0-2)

Đào tạo trình độ: Đại học

Học phần tiên quyết: [Kế toán tài chính](#), [Quản trị tài chính](#)

2. Thông tin về giảng viên:

Họ và tên: Lê Thị Thùy Dương Chức danh, học hàm, học vị: ThS

Điện thoại: Email: duongltt@ntu.edu.vn

Phạm Thị Phương Uyên Chức danh, học hàm, học vị: Thạc sỹ

Điện thoại: Email: uyenptp@ntu.edu.vn

Phan Thị lệ Thúy Chức danh, học hàm, học vị: Thạc sỹ

Điện thoại: Email: thuyp1@ntu.edu.vn

Địa điểm, lịch tiếp SV: Văn phòng Bộ môn Tài chính, Tầng 5, Khu nhà đa năng

3. Mô tả tóm tắt học phần: Trang bị kiến thức và kỹ năng cần thiết để tham gia lập và thẩm định một dự án đầu tư về các khía cạnh phân tích thị trường đầu ra, phân tích các yếu tố đầu vào và tổ chức nhân sự, phân tích tài chính, và phân tích kinh tế xã hội.

4. Mục tiêu: Giúp sinh viên có kiến thức và kỹ năng cần thiết để phục vụ hiệu quả cho công việc tham gia lập và thẩm định một dự án đầu tư

5. Kết quả học tập mong đợi (KQHT):

a) Hiểu các kiến thức tổng quan về đầu tư, dự án đầu tư, lập và thẩm định dự án đầu tư.

b) Phân tích được các nội dung về thị trường đầu ra của sản phẩm dịch vụ của một dự án đầu tư.

c) Phân tích được các nội dung cơ bản về các yếu tố đầu vào và tổ chức nhân sự của một dự án đầu tư.

d) Biết dự tính vốn đầu tư, doanh thu, chi phí, lãi lỗ, xây dựng ngân lưu, tính toán các chỉ tiêu hiệu quả tài chính và phân tích rủi ro tài chính của một dự án đầu tư, biết sử dụng phần mềm excel và crystal ball để phân tích tài chính dự án đầu tư.

e) Xây dựng ngân lưu theo quan điểm kinh tế và biết phân tích các chỉ tiêu hiệu quả kinh tế xã hội của một dự án đầu tư.

6. Kế hoạch dạy học:

<i>STT</i>	<i>Chương/Chủ đề</i>	<i>Nhằm đạt KQHT</i>	<i>Số tiết</i>	<i>Phương pháp dạy – học</i>	<i>Chuẩn bị của người học</i>
1 1.1 1.2 1.3 1.4	Tổng quan về lập và thẩm định dự án đầu tư Đầu tư Dự án đầu tư Lập dự án đầu tư Thẩm định dự án đầu tư	a a a a	6	Thuyết giảng và thảo luận nhóm	Làm việc nhóm
2 2.1 2.2 2.3 2.4	Phân tích thị trường Xác định thị trường mục tiêu Xác định cung cầu hiện tại Dự báo cung cầu tương lai Phân tích khả năng cạnh tranh và chiếm lĩnh thị trường	b b b b	7	Thuyết giảng và thảo luận nhóm	Làm việc nhóm
3 3.1 3.2 3.3 3.4 3.5 3.6 3.7	Phân tích kỹ thuật và tổ chức nhân sự Công suất Địa điểm Thiết kế, xây dựng, và tổ chức thi công Công nghệ, thiết bị Nguyên vật liệu, nhiên liệu, điện, nước Tác động môi trường Tổ chức nhân sự	c c c c c c c	8	Thuyết giảng và thảo luận nhóm	Làm việc nhóm
4 4.1 4.2 4.3 4.4 4.5	Phân tích tài chính Dự tính vốn đầu tư và nguồn vốn Dự tính doanh thu, chi phí, lãi lỗ Xây dựng kế hoạch ngân lưu	d d d d d	20	Thuyết giảng , làm bài tập và thảo luận nhóm	Làm bài tập và Làm việc nhóm

	Phân tích các chỉ tiêu hiệu quả tài chính Phân tích rủi ro tài chính				
--	---	--	--	--	--

7. Tài liệu dạy và học:

STT	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Tài liệu chính	Tham khảo
1	Lê Thị Thùy Dương	Lập và thẩm định dự án đầu tư	2016	LH nội bộ	Thư viện	x	
2	Nguyễn Bạch Nguyệt	Giáo trình lập dự án đầu tư	2012	NXB Đại học Kinh tế Quốc dân	Thư viện		x
3	Vũ Công Tuấn	Thiết lập và thẩm định dự án đầu tư : Lý thuyết và bài tập	2010	NXB thống kê	Thư viện		x

8. Yêu cầu của giảng viên đối với học phần:

- Sinh viên tham gia lớp học chuyên cần (có điểm danh đánh giá kết quả học tập cuối kỳ)
- Xem lại các kiến thức đã học có liên quan tới môn học
- Tham gia nhóm : học tập, làm việc và làm bài kiểm tra theo nhóm (mỗi nhóm từ 3 đến 5 thành viên)
- Có thái độ tích cực, chủ động trong xây dựng bài học, học nhóm và giải quyết tình huống giữa các nhóm.

9. Đánh giá kết quả học tập:

9.1 Lịch kiểm tra giữa kỳ (dự kiến):

Lần kiểm tra	Tiết thứ	Hình thức kiểm tra	Chủ đề/Nội dung được kiểm tra	Nhằm đạt KQHT
1	Tuần cuối theo lịch học	Viết	Bài kiểm tra đánh giá tổng hợp các kiến thức đã học	a,b,c,d,e

9.2 Thang điểm học phần:

STT	Hình thức đánh giá	Nhằm đạt KQHT	Trọng số (%)
1	Điểm các lần kiểm tra giữa kỳ, chuyên cần	a,b,c,d,e	50%

	và bài tập nhóm		
2	Thi kết thúc học phần - Hình thức thi: Viết - Đề mở: X Đề đóng: ..	a,b,c,d,e	50%

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN
(Ký và ghi họ tên)

ThS. Lê Thị Thùy Dương ThS Phan Thị Lệ Thúy ThS. Phạm Thị Phương Uyên

TRƯỞNG KHOA/VIỆN
(Ký và ghi họ tên)

TRƯỞNG BỘ MÔN
(Ký và ghi họ tên)

GHI CHÚ: Cách trình bày một số nội dung của Đề cương chi tiết học phần

(Lưu ý: Lược bỏ phần Ghi chú này và các con số chỉ nội dung ghi chú trên các trang 1, 2 trước khi in hoặc công bố)

- (1) Lấy từ Đề cương học phần (ĐCHP).
- (2) Nếu có nhiều giảng viên cùng dạy (kể cả trợ giảng và giảng viên hướng dẫn thực hành) thì liệt kê đầy đủ các thông tin trên cho từng giảng viên.
- (3) STT, Chương/Chủ đề, Nhằm đạt KQHT, Số tiết: lấy từ ĐCHP.
Phần Phương pháp dạy-học: Ghi phương pháp được sử dụng.
(VD: Thuyết giảng, Thảo luận nhóm, Semina SV, Tìm hiểu thực tế, ...)
Phần Chuẩn bị của người học: cho biết SV cần đọc trước tài liệu nào, số trang/chương/mục và các nội dung chuẩn bị khác.
- (4) Lấy từ ĐCHP và có thể đưa thêm các tài liệu mới hoặc thay bằng tài liệu cập nhật hơn nếu cần thiết.
- (5) Các yêu cầu của giảng viên đối với SV về hoạt động lên lớp, đọc tài liệu, làm bài tập, thực hành, tiểu luận, xử lý khi vi phạm, kiểm tra – thi và các hoạt động khác... Các yêu cầu được xây dựng dựa trên các quy định về đào tạo của trường và những đòi hỏi riêng của học phần.
- (6) Lịch kiểm tra giữa kỳ do (nhóm) GV dạy HP dự kiến. Thang điểm HP dựa trên ĐCHP.

Lưu ý chung:

- Các học phần Thực hành độc lập cũng phải có Đề cương chi tiết học phần (ĐCCTHP) riêng.
- Những nội dung “lấy từ ĐCHP” cần được ghi lại trong ĐCCTHP để SV tiện tham khảo.
- ĐCCTHP cần được Trưởng bộ môn phê duyệt (lưu bản cứng tại bộ môn) và đưa file lên trang web bộ môn.
- ĐCCTHP cần được (nhóm) GV dạy HP rà soát, cập nhật hàng năm khi có sự điều chỉnh về các nội dung liên quan hoặc khi ĐCHP được điều chỉnh.

TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG

Khoa/Viện: Kế toán – Tài chính

Bộ môn: Tài chính – Ngân hàng

ĐỀ CƯƠNG HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần

Tên học phần:

- Tiếng việt: **MÔ HÌNH TÀI CHÍNH**
- Tiếng anh: FINANCIAL MODEL

Mã học phần: **FIB359** Số tín chỉ: 3 (3-0)

Đào tạo trình độ: Đại học

Học phần tiên quyết: Đã hoàn thành các môn học Quản trị tài chính, quản trị tài chính nâng cao, Thị trường chứng khoán.

2. Mô tả học phần

Môn học này trang bị cho học viên những kiến thức lý thuyết nền tảng về thiết lập các mô hình tài chính hỗ trợ cho việc ra các quyết định tài chính. Cụ thể, Thiết lập mô hình tài chính doanh nghiệp, bài toán tối ưu, các phép tính tài chính cơ bản và chi phí sử dụng vốn, mô hình quản lý danh mục đầu tư và tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống và không có bán khống, tính toán giá trị chịu rủi ro-VAR.....

3. Mục tiêu

Trang bị cho người học những cơ sở lý luận và thực tiễn về thiết lập các mô hình tài chính hỗ trợ cho việc ra các quyết định tài chính, Sau khi học xong học phần này người học có những kiến thức nền tảng về thiết lập các mô hình tài chính phục vụ cho việc ra các quyết định trong tài chính, có khả năng công tác tại các công ty tài chính, chứng khoán, các quỹ đầu tư, các công ty cổ phần và có khả năng hiểu, đánh giá, lựa chọn tham gia các hoạt động đầu tư tài chính một cách chủ động.

4. Kết quả học tập mong đợi (KQHT):

Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

a) Vận dụng các kiến thức đã học để xây dựng và thiết lập mô hình tài chính đối với các hoạt động tài chính.

b) Xây dựng được mô hình bằng bảng tính và xác định các điều kiện ràng buộc và tối ưu trong điều kiện ràng khi lập mô hình tài chính. Thiết lập công thức và xây dựng mô hình Forfolio, mô hình quỹ hưu bổng và mô hình tối ưu hóa trong điều kiện không chắc chắn.

c) Vận dụng các mô hình tối ưu trong việc giải quyết các bài toán về quản lý danh mục đầu tư, tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống và không có bán khống, ước lượng hệ số BETA và đường thị trường chứng khoán-SML.

d) Sử dụng các công cụ Solver, Goalseek để giải bài toán tối ưu hóa tuyến tính và phi tuyến tính trong tài chính.

e) Biết cách tính toán giá trị trung bình và phương sai của danh mục, tính toán tỷ suất sinh lợi kỳ vọng và phương sai của danh mục. xác định danh mục đầu tư hiệu quả trường hợp 2 chứng khoán và n chứng khoán.

f) Đọc kết quả và đề xuất một giải pháp, gợi ý trong đầu tư tài chính.

5. Nội dung:

<i>STT</i>	<i>Chương/Chủ đề</i>	<i>Nhằm đạt KQHT</i>	<i>Số tiết</i>
1	Chủ đề 1. Tổng quan về lập mô hình tài chính		13
1.1	Tổng quan về Lập mô hình tài chính	a,b,c	
1.2	Lập mô hình bảng tính.	a,b,c	
1.3	Mô hình công ty SP	a,b,c,d,f	
1.4	Mô hình công ty C	a,b,c,d,f	
2	Chủ đề 2. Mô hình tối ưu hóa tuyến tính		10
2.1	Giới thiệu mô hình tối ưu	a,b,c,	
2.2	Mô hình tối ưu hóa tuyến tính.	a,b,e	
2.3	Sử dụng solver cho bài toán tối ưu tuyến tính	a,b,e,f	
2.4	Mô hình tuyến tính Công ty đồ gỗ C	e,d,f	
3	Chủ đề 3. Mô hình tối ưu hóa phi tuyến		10
3.1	Giới thiệu Mô hình tối ưu hóa phi tuyến tính trong tài chính.	a,b,c	
3.2	Mô hình mô phỏng Monte Carlo		

3.3	Các tình huống tài chính trong điều kiện ràng buộc và có biến số	a,b,c,d a,b,c,e	
3.4	Bài toán lưu trữ	b,c,d,e,f	
4	Chủ đề 4. Mô hình quản lý danh mục đầu tư		12
4.1	Giới thiệu các mô hình danh mục đầu tư chứng khoán	a,b,c	
4.2	Tính toán ma trận hiệp phương sai	a,c,d,e,f	
4.3	Tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống, ước lượng hệ số BETA và đường thị trường chứng khoán-SML.	a,b,c	
4.4	Mô hình danh mục đầu tư trong trường hợp không có bán khống.	a,b,c,d,e,f	

6. Tài liệu dạy và học:

T T	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Học	Tham khảo
1	Trần Ngọc Thơ & Vũ Việt Quảng	Lập mô hình tài chính	2007	Đại học Kinh tế TP Hồ Chí Minh	Thư Viện, Nguyễn Văn Báu	x	
2	Sergio M. Focardi, Frank J. Fabozzi	The Mathematics of Financial Modeling and Investment Management	2004	John Wiley & Sons Inc	Nguyễn Văn Báu		x
3	Nguyễn Khắc Minh	Mô hình tài chính quốc tế	2009	Khoa học và kỹ thuật	Thư viện		x

4	Đỗ Thiên Anh Tuân	Định giá các lợi ích tài chính qua các hàm tài chính Excel	2009	Thống kê	Thư viện, Nguyễn Văn Bảy, http://www .vinabook. com	x
---	----------------------	---	------	-------------	--	---

7. Đánh giá kết quả học tập:

<i>STT</i>	<i>Hình thức đánh giá</i>	<i>Nhằm đạt KQHT</i>	<i>Trọng số (%)</i>
1	Các lần kiểm tra giữa kỳ	a - f	20
2	Thuyết trình, thảo luận	a - f	20
3	Chuyên cần/thái độ	a - f	10
4	Thi kết thúc học phần	a - f	50

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN (Ký và ghi họ tên)

ThS. Nguyễn Văn Bảy ThS. Phan Thị Khánh Trang

TRƯỞNG KHOA/VIỆN
(Ký và ghi họ tên)

TRƯỞNG BỘ MÔN
(Ký và ghi họ tên)

Nguyễn Văn Bảy

TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG
Khoa/Viện: Kế toán – Tài chính
Bộ môn: Tài chính – Ngân hàng

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần

Tên học phần:

- Tiếng việt: **MÔ HÌNH TÀI CHÍNH**

- Tiếng anh: FINANCIAL MODEL

Mã học phần: **FIB359** Số tín chỉ: 3 (3-0)

Đào tạo trình độ: Đại học

Học phần tiên quyết: Đã hoàn thành các môn học Quản trị tài chính, quản trị tài chính nâng cao, Thị trường chứng khoán.

2. Thông tin về giảng viên

Họ và tên CBGD:

Nguyễn Văn Bảy

Chức danh, học hàm, học vị: Thạc sỹ

Điện thoại:

Email: uyenptp@ntu.edu.vn

Phan Thị Khánh Trang

Chức danh, học hàm, học vị: Thạc sỹ

Điện thoại:

Email: trangptk@ntu.edu.vn

Địa điểm, lịch tiếp SV: Văn phòng Bộ môn Tài chính, Tầng 5, Khu nhà đa năng

3. Mô tả học phần

Môn học này trang bị cho học viên những kiến thức lý thuyết nền tảng về thiết lập các mô hình tài chính hỗ trợ cho việc ra các quyết định tài chính. Cụ thể, Thiết lập mô hình tài chính doanh nghiệp, bài toán tối ưu, các phép tính tài chính cơ bản và chi phí sử dụng vốn, mô hình quản lý danh mục đầu tư và tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống và không có bán khống, tính toán giá trị chịu rủi ro-VAR.....

4. Mục tiêu

Trang bị cho người học những cơ sở lý luận và thực tiễn về thiết lập các mô hình tài chính hỗ trợ cho việc ra các quyết định tài chính, Sau khi học xong học phần này người học có những kiến thức nền tảng về thiết lập các mô hình tài chính phục vụ cho việc ra các quyết định trong tài chính, có khả năng công tác tại các công ty tài chính, chứng khoán, các quỹ đầu tư, các công ty cổ phần và có khả năng hiểu, đánh giá, lựa chọn tham gia các hoạt động đầu tư tài chính một cách chủ động.

5. Kết quả học tập mong đợi (KQHT):

Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

a) Vận dụng các kiến thức đã học để xây dựng và thiết lập mô hình tài chính đối với các hoạt động tài chính.

b) Xây dựng được mô hình bằng bảng tính và xác định các điều kiện ràng buộc và tối ưu trong điều kiện ràng khi lập mô hình tài chính. Thiết lập công thức và xây dựng mô hình Forfolio, mô hình quỹ hưu bổng và mô hình tối ưu hóa trong điều kiện không chắc chắn.

c) Vận dụng các mô hình tối ưu trong việc giải quyết các bài toán về quản lý danh mục đầu tư, tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống và không có bán khống, ước lượng hệ số BETA và đường thị trường chứng khoán-SML.

d) Sử dụng các công cụ Solver, Goalseek để giải bài toán tối ưu hóa tuyến tính và phi tuyến tính trong tài chính.

e) Biết cách tính toán giá trị trung bình và phương sai của danh mục, tính toán tỷ suất sinh lợi kỳ vọng và phương sai của danh mục. xác định danh mục đầu tư hiệu quả trường hợp 2 chứng khoán và n chứng khoán.

f) Đọc kết quả và đề xuất một giải pháp, gợi ý trong đầu tư tài chính.

6. Kế hoạch dạy học:

6.1 Lý thuyết:

STT	Chương/Chủ đề	Nhằm đạt KQHT	Số tiết	Phương pháp dạy – học	Chuẩn bị của người học
1	Chủ đề 1. Tổng quan về lập mô hình tài chính		13	Thuyết giảng, Thảo luận	- Đọc Q.1 tr. 1-48,
1.1	Tổng quan về Lập mô hình tài chính	a,b,c		Giảng giải, nêu vấn đề, thảo luận nhóm và thực hành trên máy tính	- Chuẩn bị bài trong sheel1 của file dữ liệu Công ty SP và Công ty ABC
1.2	Lập mô hình bảng tính.	a,b,c			
1.3	Mô hình công ty SP	a,b,c,d,f			
1.4	Mô hình công ty C	a,b,c,d,f			
2	Chủ đề 2. Mô hình tối ưu hóa tuyến tính		10	Giảng giải, nêu vấn đề và thực hành trên máy	- Đọc Q.1 tr.52-76.
2.1	Giới thiệu mô hình tối ưu	a,b,c,			Chuẩn bị bài

2.2	Mô hình tối ưu hóa tuyến tính.	a,b,e		tính.	trong sheel1 của file dữ liệu
2.3	Sử dụng solver cho bài toán tối ưu tuyến tính	a,b,e,f			Đọc Q1. tr. 100-172
2.4	Mô hình tuyến tính Công ty đồ gỗ C	e,d,f			Chuẩn bị bài trong sheel1 của file dữ liệu.
3	Chủ đề 3. Mô hình tối ưu hóa phi tuyến		10	Giảng giải, nêu vấn đề và thực hành trên máy tính.	Chuẩn bị bài trong sheel1 của file dữ liệu
3.1	Giới thiệu Mô hình tối ưu hóa phi tuyến tính trong tài chính.	a,b,c			Đọc Q1. tr. 100-172
3.2	Mô hình mô phỏng Monte Carlo	a,b,c,d			Chuẩn bị bài trong sheet 22-27 của file dữ liệu
3.3	Các tình huống tài chính trong điều kiện ràng buộc và có biến số	a,b,c,e			
3.4	Bài toán lưu bông	b,c,d,e,f			
4	Chủ đề 4. Mô hình quản lý danh mục đầu tư		12	Giảng giải, nêu vấn đề và thực hành trên máy tính.	- Đọc Q.1 tr. 275-295, chuẩn bị dữ liệu sheet 6
4.1	Giới thiệu các mô hình danh mục đầu tư chứng khoán	a,b,c			
4.2	Tính toán ma trận hiệp phương sai	a,c,d,e,f			- Đọc Q.1 tr. 288-295
4.3	Tính toán danh mục đầu tư chứng khoán hiệu quả trong trường hợp có bán khống, ước lượng hệ số BETA và đường thị trường chứng khoán-SML.	a,b,c			- Đọc Q.1 tr.301-315, chuẩn bị dữ liệu sheet 7
4.4	Mô hình danh mục đầu tư trong trường hợp không có bán khống.	a,b,c,d,e,f			- Đọc Q.1 tr. 329-337. Chuẩn bị dữ liệu sheet 8,

					9
--	--	--	--	--	---

7. Tài liệu dạy và học:

T T	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Học	Tham khảo
1	Trần Ngọc Thơ & Vũ Việt Quảng	Lập mô hình tài chính	2007	Đại học Kinh tế TP Hồ Chí Minh	Thư Viện, Nguyễn Văn Bảy	x	
2	Sergio M. Focardi, Frank J. Fabozzi	The Mathematics of Financial Modeling and Investment Management	2004	John Wiley & Sons Inc	Nguyễn Văn Bảy		x
3	Nguyễn Khắc Minh	Mô hình tài chính quốc tế	2009	Khoa học và kỹ thuật	Thư viện		x
4	Đỗ Thiên Anh Tuân	Định giá các lợi ích tài chính qua các hàm tài chính Excel	2009	Thống kê	Thư viện, Nguyễn Văn Bảy, http://www.vinabook.com		x
							x

8. Yêu cầu của giảng viên đối với học phần:

+ Tham gia đầy đủ các giờ học trên lớp, không làm việc riêng khi vào giờ học, vắng học phải có lý do chính đáng.

- + Người học phải chuẩn bị đầy đủ các bài tập, báo cáo do giảng viên yêu cầu.
- + Tham gia đầy đủ các giờ bài tập, thảo luận trên lớp.
- + Tham gia đầy đủ các hoạt động thảo luận nhóm.
- + Có đầy đủ tài liệu học tập theo yêu cầu của giảng viên.

9. Đánh giá kết quả học tập:

9.1 Lịch kiểm tra giữa kỳ (dự kiến):

Lần kiểm tra	Tiết thứ	Hình thức kiểm tra	Chủ đề/Nội dung được kiểm tra	Nhằm đạt KQHT
1	26	Máy tính+ Viết	Lập mô hình trên máy	a,b,c,d,e,f
2	45	Máy tính+ Viết	Lập mô hình trên máy	a,b,c,d,e,f

9.2 Thang điểm học phần:

STT	Hình thức đánh giá	Nhằm đạt KQHT	Trọng số (%)
1	Các lần kiểm tra giữa kỳ	a - f	20
2	Thuyết trình, thảo luận	a - f	20
3	Chuyên cần/thái độ	a - f	10
4	Thi kết thúc học phần - Hình thức thi: Thi trên máy - Đề mở: <input checked="" type="checkbox"/> Đề đóng: <input type="checkbox"/>	a - f	50

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN
(Ký và ghi họ tên)

ThS. Nguyễn Văn Bảy ThS. Phan Thị Khánh Trang

TRƯỞNG KHOA/VIỆN
(Ký và ghi họ tên)

Q.TRƯỞNG BỘ MÔN
(Ký và ghi họ tên)

Nguyễn Văn Bảy